

汇添富收益快线货币市场基金

2013 年第 2 季度报告

2013 年 6 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2013 年 7 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 7 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	添富快线	
交易代码	519888	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 21 日	
报告期末基金份额总额	508,067,067,260.00 份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金的投资将遵循安全性和流动性优先原则，以宏观经济和货币政策分析为基础，在严格控制风险的前提下，合理构建并及时调整投资组合，力争获得稳健的、超越业绩比较基准的收益。	
业绩比较基准	活期存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	汇添富收益快线 A	汇添富收益快线 B
下属两级基金的交易代码	519888	519889
报告期末下属两级基金的份额总额	369,125,663,837.00 份	138,941,403,423.00 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2013 年 4 月 1 日 — 2013 年 6 月 30 日 ）	
	汇添富收益快线 A	汇添富收益快线 B
1. 本期已实现收益	55,948,609.61	99,807,234.28
2. 本期利润	55,948,609.61	99,807,234.28
3. 期末基金资产净值	3,691,256,638.37	1,389,414,034.23

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富收益快线 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.8502%	0.0023%	0.0873%	0.0000%	0.7629%	0.0023%

注：本基金收益分配按日结转份额。

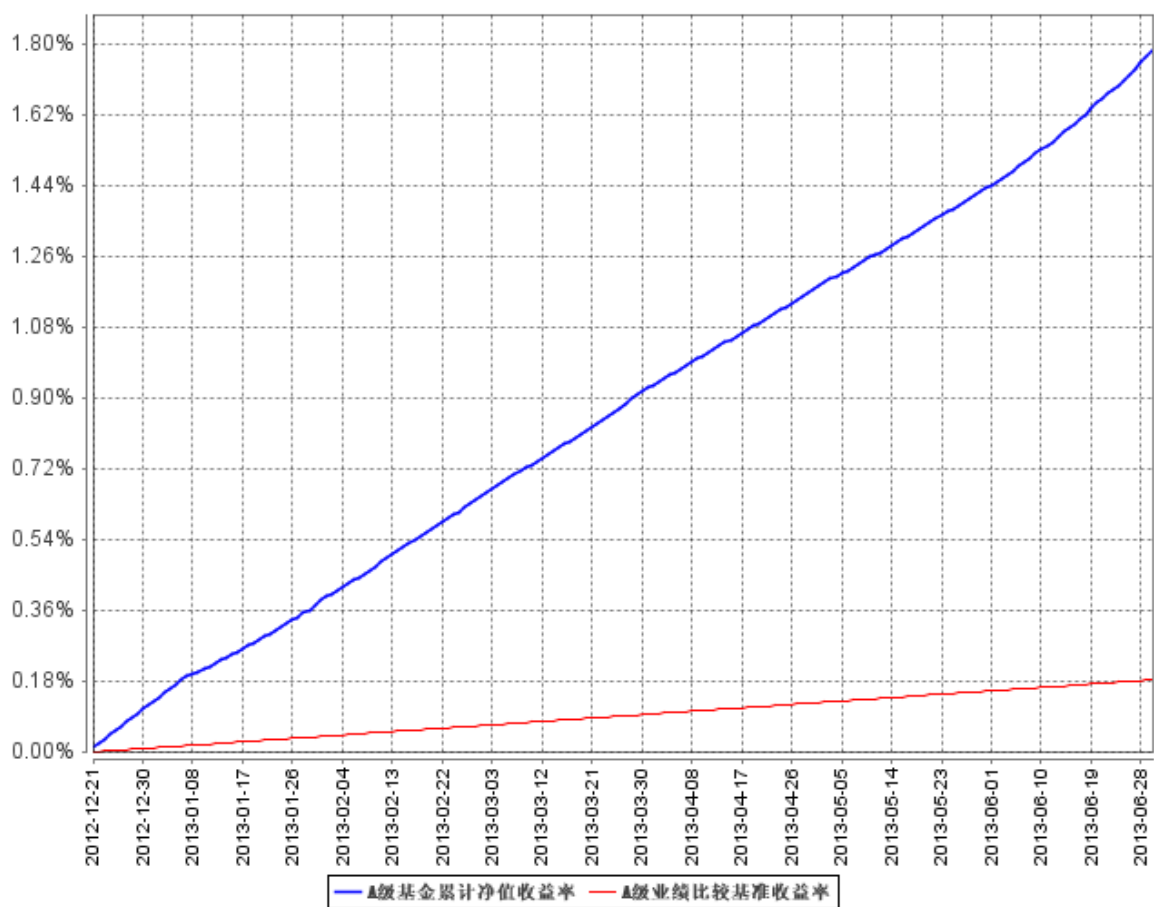
汇添富收益快线 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0007%	0.0023%	0.0873%	0.0000%	0.9134%	0.0023%

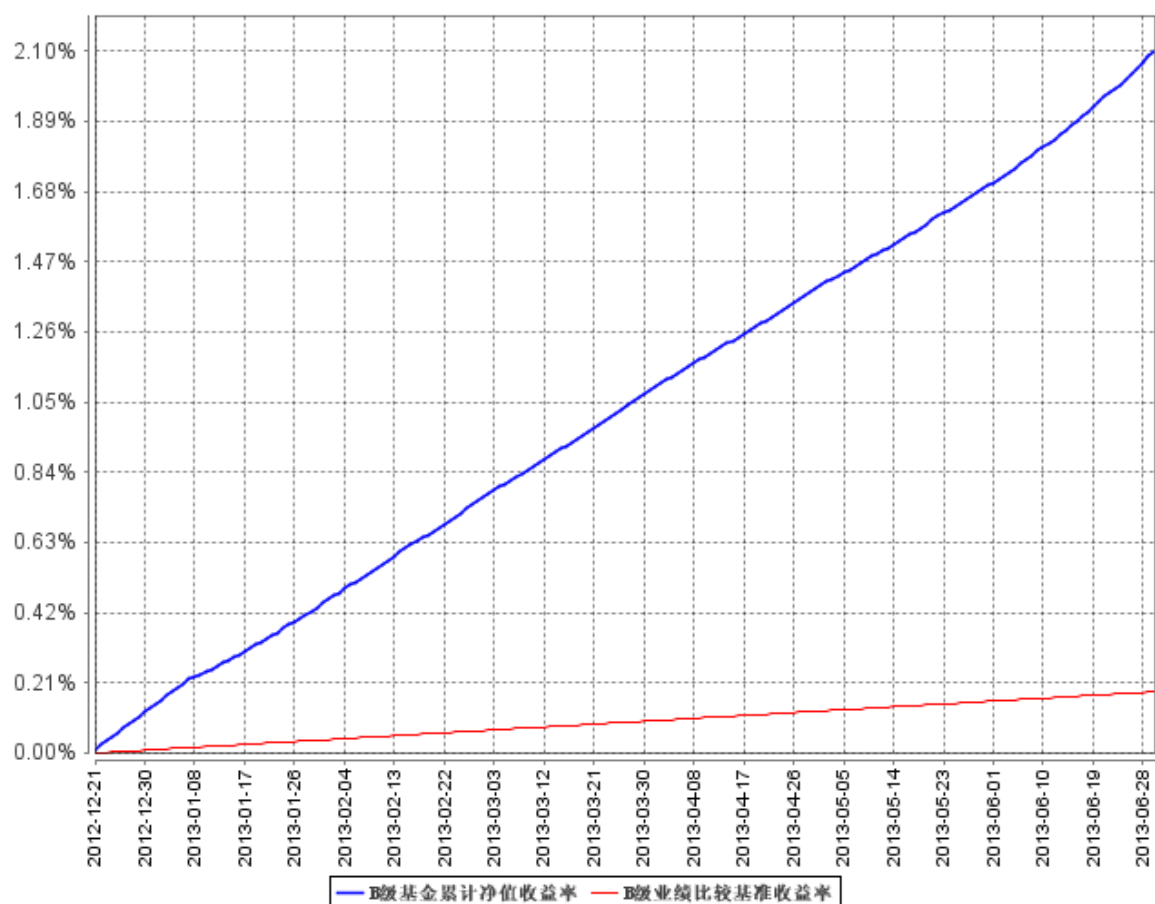
注：本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的《基金合同》生效日为 2012 年 12 月 21 日，截至本报告期末，基金成立未满 1 年；本基金建仓期为自《基金合同》生效之日（2012 年 12 月 21 日）起 6 个月，截止本报告期末，本基金建仓已完毕。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈 加 荣	汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，汇添富高息债	2012 年 12 月 21 日	-	12 年	国籍：中国。学历：天津大学管理工程硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾在中国平安集团任债券研究员、交易员及本外币投资经理，国联安基金公司任基金经理助理、债券组合经理，农银汇理基金公司任固定收益投资负责人。2008 年 12 月 23 日到 2011 年 3 月 2 日任农银汇理恒久增利债券型证券投资基金的基金经

	债券型证券投资基金的基金经理。				理，2009 年 4 月 2 日到 2010 年 5 月 9 日任农银汇理平衡双利混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 3 月加入汇添富基金管理有限公司任金融工程部高级经理，2012 年 12 月 21 日至今任汇添富收益快线货币市场基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 2 月 7 日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理，2013 年 6 月 27 日至今任汇添富高息债债券型证券投资基金的基金经理。
--	-----------------	--	--	--	--

- 注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；
- 2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；
- 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护，根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，借鉴国际经验，建立了健全、有效的公平交易制度体系，形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合，交易所市场、银行间市场等各投资市场，债券、股票、回购等各投资标的，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化，确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行，包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内，通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，同时加强对基金、专户、社保间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5% 的交易次数为 2 次，分别是由于基金流动性需要、专户组合到期清算卖出证券所致。本基金于本报告期内未出现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年二季度美国经济维持复苏态势，就业和房地产市场继续好转，市场对美联储退出量化宽松的预期明显加强，全球金融市场波动加剧，美国长期国债收益率大幅抬升。国内经济增长依然不及预期，二季度主要经济指标继续回落，通胀保持低位运行，受半年末效应和外行占款大幅波动等因素影响，6 月份债券市场资金面出现极度紧张，回购利率创出历史新高。

二季度货币市场资金面前松后紧，债券市场先扬后抑，市场波动有所加剧，4-5 月份资金面非常宽松，短期债券收益率均维持低位，6 月份金面极度紧张的影响，短期债券收益率大幅飙升。本基金主要以短期债券和存款为配置资产，二季度对债券资产进行的一定的积极操作，由于对流动性资产准备较为充分，6 月末资金面的紧张并未对本基金的投资造成明显影响，基金收益保持稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 级净值增长率为 0.8502%，B 级净值增长率为 1.0007%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着美国经济继续复苏，下半年美联储何时正式开始退出 QE 将越来越成为市场关注焦点，全球流动性格局和资金流向的改变对市场的影响值得密切关注。国内经济继续处于调结构、去产能的转型过程中，政府对经济增速偏低的容忍度会有所提高，短期内出台新的刺激政策可能性较低，在内需和外需均偏弱的情况下，三季度经济增存在继续回落的可能。在经济增速偏低、输入性通胀压力不大的情况下，通胀压力有望继续减弱，三季度 CPI 将保持低位运行，PPI 可能维持负增长。货币政策取向将维持中性，降息的可能性较低，如果外行占款下降较快，存在降准可能，

此外，6 月末资金面的极度紧张可能会促使监管层对银行表外业务的监管力度逐渐加强，在这一政策导向下，下半年货币市场资金面可能比上半年有所收紧，回购融资成本可能比上半年有所提高。本管理人将兼顾流动性和收益性目标对组合资产进行积极调整，力争在控制风险的前提下为投资者创造持续稳定的收益。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,811,674,460.36	31.60
	其中：债券	1,811,674,460.36	31.60
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,000,000.00	0.70
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,994,370,486.12	52.24
4	其他资产	886,244,012.56	15.46
5	合计	5,732,288,959.04	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.32	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	399,930,200.03	7.87
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
----	----

报告期末投资组合平均剩余期限	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	62.42	8.66
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.95	-
2	30 天(含)-60 天	5.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.94	-
3	60 天(含)-90 天	6.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	4.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.53	-
5	180 天(含)-397 天 (含)	16.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		96.30	8.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	529,358,200.38	10.42
	其中：政策性金融债	529,358,200.38	10.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,282,316,259.98	25.24
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,811,674,460.36	35.66
9	剩余存续期超过 397 天的浮	350,808,108.59	6.90

	动利率债券		
--	-------	--	--

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	130212	13 国开 12	2,000,000	200,992,061.35	3.96
2	120227	12 国开 27	1,300,000	128,473,748.33	2.53
3	041360002	13 广汇集团 CP001	1,000,000	100,193,803.81	1.97
4	120233	12 国开 33	1,000,000	99,857,986.85	1.97
5	041253055	12 太西煤 CP002	700,000	70,339,440.32	1.38
6	041355017	13 华电煤 CP001	500,000	50,103,340.22	0.99
7	100230	10 国开 30	500,000	50,076,343.46	0.99
8	041352005	13 西王 CP001	500,000	50,001,099.25	0.98
9	071314002	13 银河 CP002	500,000	49,989,020.87	0.98
10	110221	11 国开 21	500,000	49,958,060.39	0.98

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.04%
报告期内偏离度的最低值	-0.17%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.04%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	45,518,803.23
2	应收证券清算款	1,313,000.00
3	应收利息	32,912,228.46
4	应收申购款	806,499,980.87

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	886,244,012.56

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富收益快线 A	汇添富收益快线 B
本报告期期初基金份额总额	615,140,179,718.00	595,212,586,824.00
本报告期基金总申购份额	8,491,786,166,490.00	5,646,150,288,632.00
减:本报告期基金总赎回份额	8,737,800,682,371.00	6,102,421,472,033.00
本报告期期末基金份额总额	369,125,663,837.00	138,941,403,423.00

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准收益快线货币市场基金募集的文件；
- 2、《汇添富收益快线货币市场基金基金合同》；
- 3、《收益快线货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内收益快线货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼 汇添富基金管理有限公司

7.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2013 年 7 月 19 日